

CBF Release

Information zum CBF Release 30. April 2012

CBF Release 30. April 2012

April 2012

Dokumentennummer: F-CON30

Dieses Dokument ist Eigentum von Clearstream Banking AG, Frankfurt (Clearstream Banking) und darf nur mit der vorab eingeholten schriftlichen Zustimmung von Clearstream Banking abgeändert werden. Die Angaben in diesem Dokument können ohne Vorankündigung geändert werden und stellen keine Verpflichtung von Clearstream Banking, einer anderen Tochtergesellschaft oder einem anderen verbundenen Unternehmen von Clearstream International S.A. dar.

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2012). Alle Rechte vorbehalten.

Xemac® (Xemac) ist eine eingetragene Marke.

Clearstream Banking AG, Frankfurt ist ein Unternehmen der Gruppe Deutsche Börse

Vorwort

Die vorliegende Information stellt Ihnen umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am 30. April 2012 für folgende Servicebereiche eingeführt werden:

- Clearing und Settlement Services;
- Custody Services;
- Connectivity Services.

Wir bitten Sie, das Dokument an alle betreffenden Stellen in Ihrem Hause weiterzuleiten.

Ansprechpartner

Bitte wenden Sie sich bei weiterem Informationsbedarf oder Fragen zu den einzelnen Themen an unseren Customer Service Domestic oder Customer Service Connectivity.

Clearstream Banking Frankfurt

Customer Service Domestic (Allgemeine Anfragen)	Telefon: +49 - (0) 69 - 211 - 1 11 77
	Fax: +49 - (0) 69 - 211 - 61 11 77
	E-Mail: csdomestic@clearstream.com

Customer Service Connectivity (Connectivity Services)	Telefon: +49 - (0) 69 - 211 - 1 15 90
	Fax: +49 - (0) 69 - 211 - 61 15 90
	E-Mail: connectfrankfurt@clearstream.com

Wir weisen unsere Kunden an dieser Stelle darauf hin, dass Telefongespräche mit Clearstream Banking - wie in der Finanzbranche üblich - in einigen Bereichen aufgezeichnet werden. Dies soll gewährleisten, dass sowohl die Interessen der Clearstream Banking als auch die ihrer Kunden bei Missverständnissen oder Fehlübertragungen geschützt sind.

Zu den Bereichen, in denen die Telefongespräche aufgezeichnet werden, gehören der Customer Service, der Treasury Dealing Room und das Back Office. Die betreffenden Telefonleitungen unterliegen einer stetigen Wartung, um einen einwandfreien Betrieb sicherzustellen.

Vorwort

Leerseite.

Inhalt

Ansprechpartner	i
-----------------------	---

1. Domestic Market Services Deutschland

1.1 Clearing und Settlement	1-1
1.1.1 Änderungen in der CASCADE Depotumsatzanzeige (KVDU) und Auftragsanzeige (KVAI)	1-1
1.1.2 Maskenänderungen in der CASCADE Erfassung Reservierungsaufträge (KNEE)	1-2
1.1.3 Maskenänderungen in der CASCADE Auftragsabwicklung Geld - Liquiditätsmanagement - Information Settlement (KNGI)	1-2
1.1.4 Maskenänderungen in der Detailinformationen der Instruktionen für die DD Direct Debit Verarbeitung (KNZI)	1-4
1.1.5 Änderungen in den Konto-Stammdaten bei Abfrage von Bankinformationen ...	1-5
1.1.6 Änderungen in CASCADE-PC	1-6

2. Custody Services

2.1 OGAW IV	2-1
2.1.1 Umsetzung der OGAW IV Richtlinie im Wertebereich/Vaults	2-1

3. Connectivity Services

3.1 Änderungen in den Kundenreports	3-1
3.1.1 Neuer Report "Manuelle Geldbuchungen"	3-1
3.1.2 Vereinheitlichung der Informationen zur CASCADE Nachrichtenabwicklung (KVNI)	3-1
3.1.3 Neue Ausprägung der "Einheit" in den Settlement Bestätigungen MT545/547 ..	3-1
3.1.4 Erweiterung des Euro Cash Clearing Reports MT942	3-2

4. Cross Border Services Deutschland

4.1 CSD links für den belgischen, deutschen und französischen Markt (ESES Märkte) ...	4-1
4.1.1 Erweiterte Angaben bei Depository Realignments	4-1

5. Kundensimulation für das April 2012 Release

Leerseite.

1. Domestic Market Services Deutschland

1.1 Clearing und Settlement

1.1.1 Änderungen in der CASCADE Depotumsatzanzeige (KVDU) und Auftragsanzeige (KVAI)

Im Feld "EINHEIT" wird zukünftig auch die Einheitsnotiz "Punkte" angezeigt.

Neues Bildschirm Layout Maske KVDU/ID:

```
TRAN: KVDU FC: ID SB: 18.11.2011#####I#DE000A0AE077#####G#7525#####
UMSATZANZEIGE                DEPOTUMSAETZE - VOLLANZEIGE
Auftr-Art: 01  WP-UEBERTRAG                Umsatzart: Gut
                EURO GC-POOLING
Eingeber   :      7999                Buchung 3.RTS/SOF    am 18.12.2011 um 12:51:09 Uhr
Auftr-Nr   :      8712539
Konto      : 7525 000                EUREX CLEARING AG, FIXED INCOME CCP
Wg Ndl     :
Kontrah    : 7999 000                MUSTER BANK AG
Wg Ndl     :
WKN/ISIN   : I DE000A0AE077 EUREX REPO EO GC ECB EAD
Nominale   :                0                Einheit : PKTE    Verwahrart: GS
Gegenwert  :                1.000.000,00-    Waehrung: EUR    Set-Day   : 18.11.2011
-- ID-KZ: 7999999999 -- PW:                ----- B790753I -- 18/11/11 -- 15:29:25 -
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF9:Auftrag
```

Neues Bildschirm Layout KVAI:

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7525#06.02.2012#
AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR   :      5077756
LAST-KTO : 7999 000                MUSTER BANK AG
GUT-KTO  : 7525 000                EUREX CLEARING AG, FIXED INCOME CCP
WKN      : I DE000A0AE077 EUREX REPO EO GC ECB EAD
NOMINALE :                0                EINHEIT: PKTE    DISPO-PRIORITAET: 4 MST
GEGENWERT:                200.000.000,00    WRG      : EUR    VWA          : GS
SET-DAY  : 27.01.2012                RTS-DVP: N      EX-TRD       :
BOERSENPL: ECAG                    EMISS-EINF: N
MATCH-STATUS : 07 RUECKNAHME MATCHING DURCH BEGUENSTIGTEN
SET-STATUS   : 1 AUFTRAG GESPERRT DURCH DEN AUFTRAGGEBER
DISPO-STATUS : 4 ABGELEHNT, GEGENSEITE FEHLT
-- ID-KZ: 7907000132 -- PW:                ----- B790758R -- 03/02/12 -- 15:06:43 --
KV0012S Auftrag wird zur STD-Verarbeitung Valuta 06.02.2012 herangezogen
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

1.1.2 Maskenänderungen in der CASCADE Erfassung Reservierungsaufträge (KNEE)

Die Feldlänge des Feldes "ANFORDERUNG" auf den Masken der Funktion "Erfassung Einzelreservierung" (KNEE/RA) und "Erfassung Dauerreservierung" (KNEE/DR) reduziert sich von 16 Vorkommastellen und 2 Nachkommastellen auf 12 Vorkommastellen und 2 Nachkommastellen. Die Änderung ist durch eine Anpassung an das Target2 System notwendig geworden.

Neues Bildschirm Layout Maske KNEE/DR:

```
TRAN: KNEE FC: DR SB:

DAUERAUFTRAG RESERVIERUNG   E R F A S S U N G

GELDKONTO: 7999 220 MUSTER BANK AG
NÄCHSTE GENERIERUNG FÜR: 05.03.2012 VERARBEITUNGSLAUF: C2F2
ÄNDERUNG MÖGLICH BIS   : 05.03.2012 12:00 UHR

OPTIONSAUSWAHL:           1 (1 - FESTBETRAG, 2 - AKT. DISPOSITIONSBETRAG)
OPTION 1: ANFORDERUNG    =   123.456.789.01,12   EUR (FESTBETRAG)

OPTION 2: ANFORDERUNG    = AKTUELLER DISPOSITIONSBETRAG
ZUSÄTZLICHE ANPASSUNG : + _____ %
                        + _____ EUR
MAXIMALE ANFORDERUNG:   _____ EUR

-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:           ----- B79074R4 -- 05/03/12 -- 09:15:53 --
KN1005I Bitte mit PF3 bestätigen
PF1:Hilfe PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch
```

1.1.3 Maskenänderungen in der CASCADE Auftragsabwicklung Geld - Liquiditätsmanagement - Information Settlement (KNGI)

Das Layout der Funktion KNGI IG "Aufträge" wird um Informationen erweitert, die einen schnelleren Überblick über den Bestand der Target2 Prozedur 6 - Instruktionen ermöglicht.

Das Feld "ANZ.AUFTRÄGE" (Anzahl der Geldaufträge) wird angezeigt. Danach folgen die Anzahl aller Belastungen links und die Anzahl aller Gutschriften mit den Summen aller Belastungen bzw. Gutschriften, die das jeweilig gewählte Auswahlkriterium erfüllen.

Ebenso wird der Saldo aller Gut- und Lastschriften (H oder S) angezeigt, die das getroffene Auswahlkriterium erfüllen.

Die Feldbezeichnung des Tages der Geldverrechnung wird gekürzt, so dass nur noch in Zeile 7 die Bezeichnung "GELDVERR." angezeigt wird.

Die beschriebenen Änderungen im Layout werden ebenfalls für die Transaktion

Auftragsabwicklung Geld für Settlement (KNEA) und die Funktionen AN (Änderung Einzelaufträge Reservierung) und LN (Löschung Einzelaufträge Reservierung) übernommen.

Bisheriges Bildschirm Layout KNIG/IG:

```

TRAN: KNIG FC: IG SB: ##02.01.2012#STD
GELDAUFTRÄGE FÜR SETTLEMENT      I N F O R M A T I O N
                                     SEITE 1
TAG DER
K GELDVERR.LAUF FRIST TYP          KTO-SOLL  KTO-HABEN          BETRAG IN EUR  VS
-----
_ 02.01.12 STD  19:00 RESERV          7999 220          555,00  150
_ 02.01.12 STD  19:00 RESERV          7998 220          444,00  225

-- ID-KZ: 7999999999 -- PW:          ----- B79075W3 -- 19/12/11 -- 09:12:56 --
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Neues Bildschirm Layout Maske KNIG/IG:

```

TRAN: KNIG FC: IG SB: 7999#220#05.03.2012#C1F3
GELDAUFTRÄGE FÜR SETTLEMENT      I N F O R M A T I O N
ANZ. AUFTRÄGE:          0          1          SEITE 1
          0,00 S      123.456.789.012,12 H  SALDO:  123.456.789.012,12 H
K GELDVERR.LAUF FRIST TYP          KTO-SOLL  KTO-HABEN          BETRAG IN EUR  VS
-----
_ 05.03.12 C1F3 09:00 RESERV          7999 220          123.456.789.01,12  150

-- ID-KZ: 7999999999 -- PW:          ----- B79074R4 -- 05/03/12 -- 09:25:18 -
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

1.1.4 Maskenänderungen in der Detailinformationen der Instruktionen für die DD Direct Debit Verarbeitung (KNZI)

Die Länge des Feldes "REFERENZ" ändert sich, indem die bisher erlaubte Feldlänge von 12 Stellen auf 80 Stellen erweitert wird.

Die Anzeige des Betrags erfolgt zukünftig mit 11 Vorkomma- und 2 Nachkommastellen.

Neues Bildschirm Layout KNZI/ID:

```

TRAN: KNZI FC: ID SB: 7999#000#05.03.2012#DD2
DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG / I N F O R M A T I O N SEITE 1
TAG DER GELDVERRECHNUNG : 05.03.2012
VERARBEITUNGSLAUF : DD2 PAKET-NR : 1
RTGS-KONTO (SOLL) : BIC DAKVDEF0AS2
RTGS-KONTO (HABEN) : BIC DAKVDEF0295
KONTO-SOLL : 7750 000 CBF-GEGENKONTO
KONTO-HABEN : 7999 000 MUSTER BANK AG
BETRAG : 12345678901,12 EUR
BUCHUNGSTEXT : 400 DIVIDENDEN
REFERENZ : 123456789012345678901245678901234567890123456789012345678901234567890
VALUTA : 05.03.2012 GENETTET KONTOSTAMM : 7999
CUSTODY : J ISIN : DE0007236101
T2-RELEVANT : J INSTRUKTIONS-ID : 00000000041738
URSPRUNG : KVG INSTR- ID GENETTET : 00000000000327
STATUS : 350 VERARBEITET

-- ID-KZ: 7999260001 -- PW: ----- B79074R4 -- 05/03/12 -- 12:21:30 --
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor
    
```

```

TRAN: KNZI FC: ID SB: ##02.01.2012#DD1
DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG / I N F O R M A T I O N SEITE 2
ENDBEGÜNSTIGTER :
NOMINALE : 12345678901,123 EUR
LAUF-NR/ORIG-LAUF-NR : 9 / 00000
TERMINART : 120
HAUPTZAHLSTELLE : 7998
ISIN : DE0007236101
VERARBEITUNGSART : 000 05.03.2012
BID : 2011122900001
TAG D.FÄLLIGKEIT : 05.03.2012

-- ID-KZ: 7999090702 -- PW: ----- B79075W3 -- 14/12/11 -- 12:30:54 --
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Züruck PF8:Vor
    
```

1.1.5 Änderungen in den Konto-Stammdaten bei Abfrage von Bankinformationen

Um zukünftig Kundenkonten Börsenplätzen zuordnen zu können, wird auf eine Identifizierung anhand der 1. Ziffer der Kontostamnummer, dem sogenannten Ortskennzeichen, verzichtet und stattdessen das Feld "Börsenplatz" genutzt.

Dies wirkt sich auf die Darstellung der Masken des Informationssystems KVAV mit der Transaktion IA und IB sowie auf die Darstellung auf Online Layouts aus.

Altes Bildschirm Layout KVAV/IA:

```

TRAN: KVAV FC: IA SB: 01#A#B#

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                           ALPHA-SUCHE
  ICP: 01   SUCHBEGRIFF VON : A          BIS : B          SEITE: 1

KZ BANKNAME /              ORT /
  ICP TEILNEHMER-NR        INTERNATIONALER CLEARINGPARTNER
  - AAREAL BANK AG         WIESBADEN
    01 7065                CP DEUTSCHLAND CBF
  - AAREAL BANK AG         WIESBADEN
    01 9933                CP DEUTSCHLAND CBF
  - AAREAL BANK AG         WIESBADEN
    01 9964                CP DEUTSCHLAND CBF
  - AAREAL BANK AG, DUBLIN BRANCH WIESBADEN
    01 7146                CP DEUTSCHLAND CBF
  - ABACUS WERTPAPIERHANDELS- KOELN
    01 9691                CP DEUTSCHLAND CBF
  - ABACUS WERTPAPIERHANDELSGESELLSCH. KOELN
    01 8705                CP DEUTSCHLAND CBF

-- ID-KZ: 7907000079 -- PW:          ----- B79074KK -- 28/02/12 -- 14:24:12 -
    
```

Neues Bildschirm Layout KVAV/IA:

```

TRAN: KVAV FC: IA SB: 01#DEU##

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                           ALPHA-SUCHE
  ICP: 01   SUCHBEGRIFF VON : DEU        BIS :           SEITE: 12

KZ BANKNAME /              ORT /
  ICP TEILNEHMER-NR        INTERNATIONALER CLEARINGPARTNER
  - DEUTSCHE BANK AG         FRANKFURT AM MAIN
    01 8945                BOERSENPLATZ: 7 EDF CP DEUTSCHLAND CBF
  - DEUTSCHE BANK AG         FRANKFURT AM MAIN
    01 8970                BOERSENPLATZ: 7 EDF CP DEUTSCHLAND CBF
  - DEUTSCHE BANK AG         FRANKFURT AM MAIN
    01 9700                CP DEUTSCHLAND CBF
  - DEUTSCHE BANK AG         FRANKFURT AM MAIN
    01 9904                CP DEUTSCHLAND CBF
  - DEUTSCHE BANK AG GTS SECURITIES ESCHBORN
    01 7330                BOERSENPLATZ: 7 EDF CP DEUTSCHLAND CBF
  - DEUTSCHE BANK AG SOND.-D. VORRATSL ESCHBORN
    01 7574                BOERSENPLATZ: 4 EDD CP DEUTSCHLAND CBF

-- ID-KZ: 7999000099 -- PW:          ----- B9998PJX -- 24/02/12 -- 18:25:30 --
    
```

1.1.6 Änderungen in CASCADE-PC

Die Änderungen für die oben beschriebenen Host Transaktionen Erfassung, Reservierung und Informationen zur Auftragsabwicklung Geld für Settlement, Informationen zu Kapitaldiensten und sonstigen Geldumsätzen sowie Bankinformationen Stammdaten werden dementsprechend in der CASCADE-PC Anwendung adaptiert und stehen ab dem 30. April 2012 zur Verfügung.

1.1.6.1 Ergänzungen in der Wertpapieradministration

Im Rahmen der laufenden Erweiterungen der CASCADE-PC Funktionalitäten stehen den Kunden ab dem April Release neue Funktionalitäten aus dem Bereich Tresor Wertpapieradministration zur Verfügung.

Im November 2011 wurde das Instruieren von physischen Einlieferungen von Neuzulassungen/ Valutierungen (CASCADE Auftragsart 16) und Auslieferungen/Revalutierungen (CASCADE Auftragsart 18) über CASCADE-PC ermöglicht. Nun wird CBF die Anwendung um die Informationsdialoge der Tresor Stückeverwaltung und Auftragshistorie erweitern.

- Um die Informationen für den Wertebereich zu vervollständigen, wird die Informationsfunktion KCKI "Information Urkundenbestand" in CASCADE-PC dargestellt werden.
- Zusätzlich kann der Kunde mit der Funktion KPHI die Auftragshistorie (Ein- und Auslieferung) der Auftragsarten AA16 und AA18 bei der CBF Prüfstelle überwachen.
- Es wird keine Änderungen bei den aktuell zu verarbeitenden Tresorprozessen geben, was bedeutet, dass alle Informationen und Verarbeitungen wie bisher von CASCADE und CARAD abgewickelt werden.

Folgende Funktionalitäten werden in CASCADE-PC dargestellt:

- Informationen Urkundenbestand
 - Informationen Urkunden
 - Information Stückenummernsuche
- Auftragshistorie Wertebereich
 - Historische Einlieferungen Direkteinstieg
 - Historische Auslieferungen Direkteinstieg

Um weitere detailliertere Informationen über die neuen CASCADE-PC Funktionalitäten zu erhalten, verweisen wir auf das CASCADE-PC Benutzerhandbuch im Download Bereich der Clearstream Homepage.

1.1.6.2 Voraussetzungen

Da es sich um ein verpflichtendes Release handelt, müssen alle CASCADE-PC Kunden sicherstellen, dass ihre Systeme rechtzeitig mit der neuen CASCADE-PC Version 7.6 angepasst werden. Diese steht ab dem 16.04.2012 auf der Clearstream Homepage zum Download zur Verfügung.

2. Custody Services

2.1 OGAW IV

Durch den Beschluss des Bundesrates vom 27. Mai 2011, dem Gesetz zur Umsetzung der Richtlinie 2009/65/EG zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffenden bestimmten Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW-IV-Umsetzungsgesetz - OGAW-IV-UmsG) zuzustimmen, sind zum 1. Januar 2012 weitreichende Änderungen bzgl. des Steuerabzugsverfahrens in Kraft getreten.

Mit Umsetzung des OGAW-IV-UmsG soll die missbräuchliche steuerliche Gestaltung bei Leerverkäufen über den Dividendenstichtag unterbunden werden. Dies wird durch die Umstellung des Steuerabzuges vom Emittenten zur letzten inländischen auszahlenden Stelle erreicht. In diesem Sinne wird Clearstream Banking Frankfurt (CBF) als letzte inländische auszahlende Stelle den Steuerabzug im Falle von Dividenden- und Fondausschüttungen vornehmen.

Bei thesaurierenden Fonds verteilt CBF die von der KAG zur Verfügung gestellte Steuerliquidität an ihre inländischen Kunden bzw. führt bei Zahlung an einen ausländischen Kunden die Steuer ab. Dies betrifft sowohl die Ertragsausschüttung auf Bestände sowie Market Claims cum gehandelter und ex beliefeter Geschäfte.

Für Bestände in Sonderverwahrung bzw. Fremdtresorverwahrung ist die letzte inländische auszahlende Stelle (Hauptzahlstelle und nicht CBF) für den Steuerabzug verantwortlich.

Um den Steuermissbrauch bei Leerverkäufen ausschließen zu können und basierend auf der Tatsache, dass Leerverkäufe in Omnibus Accounts bei Abwicklungsbanken und CBF nicht zweifelsfrei erkannt werden können, werden alle Verkäufe/Lieferungen brutto belastet. Zur Verhinderung einer übermäßigen Belastung der Steuerausländer wird eine tägliche Steuer-Kontrollrechnung eingeführt.

Im Zusammenhang mit den OGAW Änderungen insbesondere zum April Release 2012 verweisen wir auf die funktionale Beschreibung auf der Clearstream Homepage (Information Center/Tax).

2.1.1 Umsetzung der OGAW IV Richtlinie im Wertebereich/Vaults

Mit Einsatz zum 30. April 2012 werden die Anforderungen aus OGAW IV auch für die Vaults Segmente 2 Sonderverwahrung und 3 Fremdtresorbestand umgesetzt.

Betroffen sind die Terminarten TA120 (Dividenden) und TA121 (Fondausschüttungen) für Wertpapiere deutscher Emittenten und ausländischer Emittenten mit abweichendem Besteuerungsland Deutschland.

Im November wurde bereits die Kupon-Abrechnung des CBF-Tresors dergestalt umgestellt, dass der ausmachende Betrag generell als Brutto-Betrag ausgewiesen wird.

Ab dem 30. April 2012 wird nun auch die Geldverrechnung in den Vaults-Segmenten 2 (Sonderverwahrung) und 3 (Fremdtresorverwahrung) auf die OGAW IV-Anforderungen umgestellt.

Vaults prüft in Zukunft für OGAW-relevante Zahlungen generell, ob der Zahlungsempfänger ein inländisches oder ausländisches Finanzinstitut ist. Sollte der Zahlungsempfänger ein ausländisches Finanzinstitut sein, dann wird prinzipiell die Geldverrechnungsart 3 (Überweisung durch Hauptzahlstelle direkt an den Zahlungsempfänger) durchgeführt.

Die Abführung der einzubehaltenden Steuern an das Betriebsstätten-Finanzamt obliegt also in diesem Fall der Hauptzahlstelle als letzter inländischer Zahlstelle.

Zur Information wird der Hauptzahlstelle auf der Kupon-Abrechnung angezeigt, ob es sich bei dem Zahlungsempfänger um ein inländisches oder ausländisches Finanzinstitut handelt.

Handelt es sich bei dem Zahlungsempfänger um ein inländisches Finanzinstitut oder ist die Zahlung nicht OGAW-relevant, erfolgt die Geldverrechnung aufgrund der mit CBF vereinbarten Art (Direktinkasso, Geldanforderung oder Überweisung Hauptzahlstelle) in Zukunft generell brutto.

Die oben beschriebenen Änderungen gelten sowohl für Zahlungen auf Bestand als auch für Kupon-Einreichungen, wenn die Kupon-Fälligkeit ab dem 01. Januar 2012 liegt. Für Kupons mit Fälligkeit vor dem 01. Januar 2012 erfolgt die Abrechnung wie bisher netto.

Gleiches gilt für die Führung von Dotationskonten. Dotationskonten für Kupons mit Fälligkeit vor dem 01. Januar 2012 werden weiterhin Netto geführt, bei Fälligkeit ab dem 01. Januar 2012 entsprechend Brutto. Der Kontoauszug wird ebenfalls um die Information des AWV Status "Inland"/ "Ausland" erweitert.

Im Zusammenhang mit den OGAW Änderungen verweisen wir auf die funktionale Beschreibung auf der Clearstream Homepage.

3. Connectivity Services

3.1 Änderungen in den Kundenreports

3.1.1 Neuer Report "Manuelle Geldbuchungen"

Von CBF manuell erfasste Geldumsätze erscheinen zukünftig auf einer gesonderten Liste, die die bis dahin manuell erstellten Zahlungsbelege ersetzt. Der Report wird einmal täglich am Folgetag der Verarbeitung, morgens nach RT-STD den Kunden automatisch zur Verfügung gestellt. Die Verteilung erfolgt mit den CASCADE Reservierungslisten auf dem bisher üblichen Weg per CMA Spool oder HOST File Service. Zusätzliche Maßnahmen zur Anforderung dieser Liste sind nicht notwendig.

Report "Manuelle Geldbuchungen":

CLEARSTREAM BANKING AG MERGENTHALERALLEE 61	MANUELLE GELDBUCHUNGEN	VERARB.DAT: CCYY/MM/DD			
MUSTER BANK AG NIEDERLASSUNG 1 D 99999 MUSTERSTADT		ZEIT: HH:MM REPORT-ID:9CL9999999999 SEITE: 001			
DEPOTKONTO-NUMMER:	8888/888				
BUCHUNG AUF GELDKONTO:	8888/000				
TAG DER GELD-VERRECHNUNG:	DD.MM.CCYY				
WIR HABEN FUER SIE FAELLIGE BUCHUNGEN GEMAESS NACHSTEHENDER EINZELPOSTEN LISTE VORGENOMMEN:					
VAL.DATUM	TEXT/TA	WP-KENN-NUMMER	NOMINALE	S/H	BETRAG (EUR)
DD.MM.CCYY	250/110	DE000A1E8K82	999.999.999.999,999	H	999.999.999.999,99
REF: XXX					
DD.MM.CCYY	250/110	DE0001145121	999.999.999.999,999	S	999.999.999.999,99
REF: XXX					
GESAMT BETRAG FUER GELDKONTO 9999/000				H	99.000.000.000,00

3.1.2 Vereinheitlichung der Informationen zur CASCADE Nachrichtenabwicklung (KVNI)

Die Informationsmaske zur Nachrichtenabwicklung (KVNI) wird vollständig abgelöst. Den Kunden steht zukünftig das CBF-Message Journal über den Transaktionscode MAMJ für die Nachrichtenüberwachung zur Verfügung. Der Funktionscode TU bietet eine technische Übersicht; der Funktionscode FU die fachliche Übersicht.

3.1.3 Neue Ausprägung der "Einheit" in den Settlement Bestätigungen MT545/547

Zum 16.02 erfolgte die Umschlüsselung der EGCP Basket ISINs auf "Punkte". Die Anzeige der Einheit "Punkte", die bereits auch für einige anderen Gattungen in CBF genutzt wird, erfolgt wie bisher über FAMT in den ISO15022 Nachrichten.

3.1.4 Erweiterung des Euro Cash Clearing Reports MT942

Bei von CBF manuell erfassten Zahlungen werden zukünftig zusätzliche Attribute verfügbar sein.

Folgende Attribute werden in MT942 angezeigt:

- Die "ISIN" steht als zusätzliches Detail zur Verfügung (Tag 61 / Subfield 9).
- Der "KADI CUSTODY EVENT TYPE" (Terminart) wird in die Corporate Action Reference (Tag 61 / Subfield 8) eingeführt.
- Die KADI BID wird in die "CORPORATE ACTION REFERENCE" (Tag 61 / Subfield 8) eingeführt.
- Das Feld "NOMINAL VALUE" wird - genauso wie bei den automatischen Instruktionen angezeigt (Tag 86).
- Für Kompensationen (Buchungstextschlüssel 312-323 und 412-427) werden die ersten 10 Stellen der "REFERENZ" (mit führenden Nullen) in Tag 61 / Subfield 7 eingefügt
 - Im Falle der Buchungstextschlüssel 425-427 enthält die "REFERENZ" die Forderungsnummer aus der zugehörigen Xemac Transaktion.
 - Für "Sonstige Geldebuchungen" (Buchungstextschlüssel 035-099) werden die ersten 16 Stellen der "REFERENZ" in Tag 61 / Subfield 7 eingefügt.
 - Sollte in beiden Fällen (Kompensationen und Sonstige Geldebuchungen) die "REFERENZ" nicht vorhanden sein, dann wird das Feld mit dem Last- bzw. Gutschriftskonto gefüllt

Altes Layout:

```

TRAN: MAMJ FC: FU SB: 05.12.2011##00:00#23:59###M###942####A#
CBF-VOLLANZEIGE                I N F O R M A T I O N                SEITE: 001
DATUM      : 05.12.2011                SCHNITTSTELLE   : MQ-SERIES
ANWENDUNG: CASH                        EINGANG/AUSGANG: A
SND/000 VERSANDNACHRICHT ERSTELLT / ---

{1:      F01MSFFDEF0XXXX1234123456}
{2:      09421527111205ZYDHDEF0AXXX01234567891112051527N}
{3: {108: CSH5152747292617}}
{4:
:20: 7999111205000001
:25: 7999
:28C: 1205/00001
:34F: EURO,
:13D: 1112051527+0100
:61: 1112051205CR35000,34NTRF7999000//0000000000000000
DD116047999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:61: 1112051205CR15000,12NTRF7999000//0000000000000000
DD113007999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:61: 1112051205DR25000,23NTRF7999000//0000000000000000
DD114027999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:61: 1112051205DR55000,56NTRF0000000000//0000000000000000
DD113157999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:61: 1112051205DR45000,45NTRF0000000000//0000000000000000
DD114257999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:61: 1112051205CR65000,67NTRF7999000//0000000000000000
DD290357999000 0000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXX
:90D: 3EUR125001,24
:90C: 3EUR115001,13
-}
{5: {TNG: }}

-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ----- B7907461 -- 05/12/11 -- 15:29:32 --
AE0100I Keine weiteren Daten vorhanden
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück
    
```


Neues Layout:

```

TRAN: MAMJ FC: FU SB: 05.12.2011##00:00#23:59###M###942####A#
CBF-VOLLANZEIGE                I N F O R M A T I O N                SEITE: 001
DATUM      : 05.12.2011                SCHNITTSTELLE   : MQ-SERIES
ANWENDUNG: CASH                        EINGANG/AUSGANG: A
SND/000 VERSANDNACHRICHT ERSTELLT / ---

{1:      F01MSFFDEF0XXXX1234123456}
{2:      09421527111205ZYDHDEF0AXXX01234567891112051527N}
{3: {108: CSH5152747292617}}
{4:
:20: 7999111205000001
:25: 7999
:28C: 1205/00001
:34F: EURO,
:13D: 1112051527+0100
:61: 1112051205CR35000,34NTRF7999000//1402011101300000
DD116047999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI5000,
:61: 1112051205CR15000,12NTRF7999000//1100000020111203
DD113007999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI120,123
:61: 1112051205DR25000,23NTRF7999000//1202011030857300
DD114027999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI47300,
:61: 1112051205DR55000,56NTRF0000000000//1100000020111205
DD113157999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI18,
:61: 1112051205DR45000,45NTRF0001234567//1201234567890123
DD114257999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI78,1
:61: 1112051205CR65000,67NTRFPREFERENZ-NR //000000000000000000
DD290357999000DE00012345670000000
:86: RTGSDAKVDEFFXXXNOMI100000000000,123
:90D: 3EUR125001,24
:90C: 3EUR115001,13
-}
{5: {TNG: }}

-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ----- B7907461 -- 05/12/11 -- 15:29:32 --
AE0100I Keine weiteren Daten vorhanden
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück

```

Leerseite.

4. Cross Border Services Deutschland

4.1 CSD links für den belgischen, deutschen und französischen Markt (ESES Märkte)

4.1.1 Erweiterte Angaben bei Depository Realignments

Bezugnehmend auf unsere Kundenveröffentlichung zum November Release 2011 möchten wir Sie darauf hinweisen, daß zum 30. April 2012 die Informationen bei Depository Realignments wie folgt angegeben werden müssen:

bei Depository Realignments (z.B. Creation nach CASCADE) für die ESES Märkte, also Frankreich, Belgien und Niederlande, wird das Feld ‚Endbegünstigter‘ zum Pflichtfeld.

Zur Zeit wird bei Depository Realignments das Konto des Endbegünstigten im Freitext und im Feld für den Endbegünstigten angegeben.

Beispiel für die Eingabe des Endbegünstigten (KVEE, Seite 1):

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / FOLGEERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS
      PRIMANOTE:          AUFTNR:    365432          WKN: I FR0000120271
BEGUENSTIGTER
DEPOTBANK : _____
INTERMED. : _____
ENDBEG.   : KTO 67171
NAME / ADRESSE: _____
AUFTRAGGEBER
DEPOTBANK : KTO 000000000641          CLEARSTREAM BANKING LUXEMBO
INTERMED. : _____
ORIG-AUFTR: _____
NAME / ADRESSE: _____
-- ID-KZ: 7900000000 -- PW:          ----- B79075QJ -- 08/06/11 -- 15:12:17 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Der Eintrag im Textfeld mit Prefix "CLEARSTREAM-A/C" sollte weiterhin erfolgen.

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2      ERFASSUNGSSTATUS
          PRIMANOTE:          AUFTNR:    365432      WKN: I FR0000120271
UEB-GRUND   : ____
EXT SET-DAY: _____      RUECKUEBERTRAG (J/N) : N
BELEGSCHAFT-SP: N          SP-DATUM: _____
KUPONINFO/RECORD-DATE: _____

TEXT: _CLEARSTREAM-A/C 67171      _____

-- ID-KZ: 7900000000 -- PW:          ----- B79075QJ -- 08/06/11 -- 15:13:38 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Beispiel für den Endbegünstigten im Freitext (KVEE, Seite 2).

5. Kundensimulation für das April 2012 Release

Vom 16. bis zum 27. April 2012 bieten wir unseren Kunden eine Simulationsphase für die Änderungen zum April 2012 Release. Die Simulation wird in der IMS23 Simulationsumgebung zu den dort üblichen Bedingungen eingerichtet.

Leerseite.

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse:

Clearstream Banking AG, Frankfurt
Mergenthalerallee 61
D-65760 Eschborn

Postanschrift

Clearstream Banking
D-60485 Frankfurt am Main

April 2012

Dokumentnummer: F-CON30
